

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016年6月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016年8月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘云端生活优选
基金主代码	001030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月17日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	578,115,802.18份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，利用公司大数据研究优势优选与居民生活密切相关的大消费及相关行业的优质企业进行投资，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置、主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是充分发挥公司大数据研究平台的优势，通过建立量化模型优选具有良好投资价值的投资品种，构建投资组合。
业绩比较基准	60%×中证主要消费指数收益率+40%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		天弘基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	林葛
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007109999	95599
传真		022-83865569	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日-2016年6月30日）
本期已实现收益	-120,024,193.21
本期利润	-104,080,878.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1743
本期基金份额净值增长率	-18.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.2571
期末基金资产净值	432,636,174.35
期末基金份额净值	0.7484

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金《基金合同》2015年3月17日起生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.45%	1.36%	2.47%	0.82%	1.98%	0.54%
过去三个月	4.41%	1.36%	3.22%	0.85%	1.19%	0.51%
过去六个月	-18.79%	2.39%	-1.24%	1.15%	-17.55%	1.24%
过去一年	-35.90%	2.40%	-6.33%	1.42%	-29.57%	0.98%
自基金合同生效日起至 至今（2015年03月17 日-2016年06月30日）	-25.16%	2.42%	9.94%	1.45%	-35.10%	0.97%

注：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准：60%×中证主要消费指数收益率+40%×中证综合债指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金《基金合同》于2015年3月17日生效。

2、按照本基金《基金合同》的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年3月17日-2015年9月16日，建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2016年6月30日，本基金管理人共管理48只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业

板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖志刚	本基金基金经理；本公司投资研究部总经理。	2015年3月	—	8年	男，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司行业研究员。2013年8月加盟本公司，历任股票研究部总经理、基金经理助理等。
李宁	本基金基金经理；本公司股票研究部总经理助理。	2015年3月	—	6年	男，管理学博士。历任中信建投证券股份有限公司行业分析师。2011年8月加盟本公司，历任本公司行业研究员等。

注：1、上述任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1月份市场经历了暴跌和“熔断”，整体跌幅较大，2月份开始市场趋于平稳，我们判断市场的风险偏好已经系统性下降，在反弹过程中逐步减持了创业板相关的高估值个股，增仓了行业趋势良好、估值在合理范围的消费类个股，主要集中在食品饮料、医药生物和品牌服饰。周期股方面，我们看好整个畜禽产业链的投资机会，畜禽价格出现反

转，行业景气度不断提高。

2季度，经济阶段性企稳回升，货币政策大体宽松，同时投资者的信心不足，增量资金缺乏，外部风险时有发生，市场总体呈窄幅震荡格局，指数上下空间都有限。在市场没有大跌风险的前提下，部分高景气、估值相对合理、或明显受益政策扶持的行业和板块则会出现投资机会，我们在2季度也积极参与了对这些领域的投资。我们认为当前市场还处在熊市后半段，在投资过程中注重景气向上及安全边际，回避前期热炒的概念品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金的基金份额净值为0.7484元，本报告期份额净值增长率为-18.79%，同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，仍然看不到可以促使市场产生单边趋势的因素，政策依然会在保增长与调结构之间权衡取舍，这一过程可能会延续全年。在去产能的过程中，经济会经历阵痛，难有大的起色，货币政策和财政政策则会进行托底，流动性将维持不紧略宽的格局。因此判断市场仍将维持震荡，尽管市场2季度出现反弹，仍不能对反弹高度过于乐观。我们在投资上会注意防范风险，将高景气和大趋势作为风险的保护伞。从估值来看，当前各板块估值处于历史均值附近或以下，其中创业板、中小板估值处于历史相对高位。

下半年市场大概率还处在震荡寻底过程，但是不少个股已经具备操作价值，未来将重点关注衰退、滞涨相对受益的品种，持续看好养殖、贵金属、食品饮料和医药等行业；3季度后通胀因素可能会对政策空间和经济运行带来压力，我们将密切关注这一变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、研究总监及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不

具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-天弘基金管理有限公司 2016年1月1日至2016年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，天弘基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	84,206,204.20	28,221,441.32
结算备付金		2,575,149.58	4,210,133.00
存出保证金		690,193.51	2,080,863.43
交易性金融资产	6.4.7.2	356,015,806.20	557,615,635.27
其中：股票投资		355,719,529.60	517,649,356.37
基金投资		—	—
债券投资		296,276.60	39,966,278.90
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	19,627.63	655,430.90
应收股利		—	—
应收申购款		309,148.90	23,772.17
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		443,816,130.02	592,807,276.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		—	—

交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	27,800,000.00
应付证券清算款		7,054,795.20	8,465,850.90
应付赎回款		1,992,181.85	1,047,803.78
应付管理人报酬		527,590.66	717,202.15
应付托管费		87,931.77	119,533.70
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,300,071.65	1,760,550.99
应交税费		—	—
应付利息		—	2,080.97
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	217,384.54	326,909.61
负债合计		11,179,955.67	40,239,932.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	578,115,802.18	599,604,262.21
未分配利润	6.4.7.10	-145,479,627.83	-47,036,918.22
所有者权益合计		432,636,174.35	552,567,343.99
负债和所有者权益总计		443,816,130.02	592,807,276.09

注：1、报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.7484元，基金份额总额578,115,802.18份。

2、本财务报表的比较期间为2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日 -2016年6月30日	上年度可比期间 2015年03月17日-2015 年06月30日
一、收入		-95,990,316.14	318,212,553.54

1. 利息收入		729,298.56	1,025,053.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	275,801.94	300,983.02
债券利息收入		259,254.65	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		194,241.97	724,070.72
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-112,868,675.05	312,033,971.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-114,477,929.41	307,815,858.73
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	153,302.41	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	1,455,951.95	4,218,112.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,943,314.41	-11,941,300.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	205,745.94	17,094,828.45
减：二、费用		8,090,562.66	18,090,450.32
1. 管理人报酬		3,156,030.12	6,698,447.59
2. 托管费		526,005.06	1,116,407.89
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	4,146,128.00	10,144,712.20
5. 利息支出		29,058.80	—
其中：卖出回购金融资产支出		29,058.80	—

6. 其他费用	6.4.7.20	233,340.68	130,882.64
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-104,080,878.80	300,122,103.22
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-104,080,878.80	300,122,103.22

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日-2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	599,604,262.21	-47,036,918.22	552,567,343.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-104,080,878.80	-104,080,878.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-21,488,460.03	5,638,169.19	-15,850,290.84
其中：1. 基金申购款	31,861,792.09	-9,614,226.42	22,247,565.67
2. 基金赎回款	-53,350,252.12	15,252,395.61	-38,097,856.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	578,115,802.18	-145,479,627.83	432,636,174.35
项 目	上年度可比期间 2015年03月17日-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,509,622,448.1	—	1,509,622,448.13

值)		3		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		—	300,122,103.22	300,122,103.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-628,936,754.6		-152,482,654.4	-781,419,409.10
	2		8	
其中：1. 基金申购款	553,044,354.01		197,352,307.13	750,396,661.14
2. 基金赎回款	-1,181,981,108.63		-349,834,961.61	-1,531,816,070.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	880,685,693.51		147,639,448.74	1,028,325,142.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]90号文注册募集。本基金为契约型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,509,378,041.33元,业经:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第189号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年3月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,509,622,448.13份基金份额,其中认购资金利息折合244,406.80份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括:国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、

公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于消费及相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%；投资于权证的比例不超过基金资产的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准： $60\% \times$ 中证主要消费指数收益率 $+40\% \times$ 中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金截止2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关

于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日-2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年03月17日-2015年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,156,030.12	6,698,447.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,389,790.07	3,342,491.39

注：1. 支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50%/ 当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日-2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年03月17日-2015年 06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	526,005.06	1,116,407.89

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内基金管理人未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日-2016年6月30日	2015年03月17日-2015年06月30日
基金合同生效日（2015年3月17日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	16,633,399.87	-
期间申购/买入总份额	-	16,633,399.87
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	16,633,399.87	16,633,399.87
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.88%	1.89%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日-2016年6月30日		2015年03月17日-2015年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	84,206,204.20	229,078.40	4,395,149.39	200,101.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方购买其承销期内的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股尚未上市流通	12.98	12.98	3,287	42,665.26	42,665.26
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股尚未上市流通	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股尚未上市流通	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股尚未上市流通	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订认购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动实施停牌	20.92	2016-07-01	23.01	11,092	38,489.24	232,044.64
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	15.00		—	315,400	4,059,924.68	4,731,000.00

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末（2016年6月30日），本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2016年6月30日），本基金未持有证券交易所债券正回购交易债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为351,052,761.56元，属于第二层次的余额为4,963,044.64元，无属于第三层次的余额。(2015年12月31日：第一层次490,846,064.27元，第二层次66,769,571.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	355,719,529.60	80.15
	其中：股票	355,719,529.60	80.15
2	固定收益投资	296,276.60	0.07
	其中：债券	296,276.60	0.07
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	86,781,353.78	19.55
7	其他各项资产	1,018,970.04	0.23
8	合计	443,816,130.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	43,727,507.17	10.11
B	采矿业	38,259,941.55	8.84
C	制造业	259,125,872.55	59.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	232,044.64	0.05
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	14,283,545.19	3.30
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	355,719,529.60	82.22

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600547	山东黄金	861,705	33,528,941.55	7.75
2	300296	利亚德	767,884	24,311,207.44	5.62
3	002458	益生股份	415,031	18,182,508.11	4.20
4	000568	泸州老窖	548,900	16,302,330.00	3.77
5	000418	小天鹅 A	479,402	15,638,093.24	3.61
6	002583	海能达	1,275,908	15,361,932.32	3.55
7	002456	欧菲光	517,100	15,254,450.00	3.53
8	600667	太极实业	1,519,500	15,179,805.00	3.51
9	002299	圣农发展	579,470	15,008,273.00	3.47
10	000534	万泽股份	959,271	14,283,545.19	3.30

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于天弘基金网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	48,894,504.46	8.85
2	002458	益生股份	46,748,464.42	8.46
3	002481	双塔食品	29,620,600.62	5.36
4	002714	牧原股份	29,506,088.59	5.34
5	000911	南宁糖业	27,511,663.39	4.98
6	300296	利亚德	25,472,647.66	4.61
7	600975	新五丰	25,383,677.93	4.59
8	600702	沱牌舍得	23,455,111.56	4.24
9	000858	五粮液	20,817,864.78	3.77
10	300389	艾比森	19,229,921.59	3.48
11	002074	国轩高科	17,546,304.89	3.18
12	600298	安琪酵母	17,037,379.57	3.08
13	002548	金新农	17,013,172.14	3.08
14	002037	久联发展	16,834,507.77	3.05
15	002299	圣农发展	16,753,781.56	3.03
16	002108	沧州明珠	16,597,583.47	3.00
17	600197	伊力特	16,596,252.90	3.00
18	000568	泸州老窖	14,954,830.34	2.71
19	002582	好想你	14,875,467.79	2.69
20	000418	小天鹅 A	14,823,073.95	2.68
21	000983	西山煤电	14,749,114.95	2.67
22	000933	神火股份	14,713,105.16	2.66
23	002583	海能达	14,606,765.98	2.64
24	600201	生物股份	14,592,507.07	2.64
25	002456	欧菲光	14,548,748.00	2.63
26	600343	航天动力	14,487,023.00	2.62

27	600562	国睿科技	14,428,805.00	2.61
28	601069	西部黄金	13,967,128.15	2.53
29	600419	天润乳业	13,320,162.00	2.41
30	600750	江中药业	12,967,093.76	2.35
31	600519	贵州茅台	12,675,033.00	2.29
32	600259	广晟有色	12,606,032.22	2.28
33	600398	海澜之家	12,580,133.02	2.28
34	000534	万泽股份	12,556,526.56	2.27
35	002094	青岛金王	12,511,596.07	2.26
36	002617	露笑科技	12,423,705.99	2.25
37	300498	温氏股份	12,307,422.34	2.23
38	600667	太极实业	12,297,337.00	2.23
39	300327	中颖电子	12,164,546.42	2.20
40	300496	中科创达	11,848,186.00	2.14
41	300036	超图软件	11,801,699.03	2.14

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	31,283,777.21	5.66
2	002458	益生股份	29,155,885.52	5.28
3	600975	新五丰	28,211,959.46	5.11
4	000911	南宁糖业	27,821,004.43	5.03
5	002481	双塔食品	27,296,429.75	4.94
6	300367	东方网力	24,541,257.07	4.44
7	000860	顺鑫农业	23,127,304.03	4.19
8	600547	山东黄金	22,496,986.74	4.07
9	600433	冠豪高新	20,629,204.20	3.73
10	002548	金新农	19,207,925.55	3.48

11	002429	兆驰股份	18,909,807.01	3.42
12	600963	岳阳林纸	18,211,461.70	3.30
13	300103	达刚路机	17,764,262.24	3.21
14	002037	久联发展	17,637,589.30	3.19
15	600419	天润乳业	17,616,538.94	3.19
16	600197	伊力特	17,384,403.92	3.15
17	300036	超图软件	17,332,140.04	3.14
18	600702	沱牌舍得	16,400,010.65	2.97
19	002321	华英农业	16,018,735.45	2.90
20	601069	西部黄金	14,839,493.44	2.69
21	002665	首航节能	14,691,522.00	2.66
22	000983	西山煤电	14,635,244.65	2.65
23	600201	生物股份	14,630,317.98	2.65
24	002582	好想你	14,617,140.00	2.65
25	300098	高新兴	14,537,298.22	2.63
26	300496	中科创达	14,048,806.20	2.54
27	000933	神火股份	13,927,863.81	2.52
28	002234	民和股份	13,319,093.87	2.41
29	002074	国轩高科	13,078,010.50	2.37
30	600735	新华锦	13,069,188.55	2.37
31	600398	海澜之家	12,387,695.73	2.24
32	000049	德赛电池	12,331,472.14	2.23
33	600867	通化东宝	12,149,251.78	2.20
34	600259	广晟有色	12,061,031.58	2.18
35	300097	智云股份	11,789,459.09	2.13
36	002299	圣农发展	11,775,421.68	2.13
37	600562	国睿科技	11,484,255.03	2.08
38	002053	云南盐化	11,463,592.10	2.07
39	002304	洋河股份	11,414,438.52	2.07
40	002407	多氟多	11,338,575.40	2.05

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,321,996,685.37
卖出股票的收入（成交）总额	1,385,577,983.78

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	296,276.60	0.07
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	296,276.60	0.07

注：可转债项下包含可交换债296,276.60元。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132003	15清控EB	2,690	296,276.60	0.07

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	690,193.51
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	19,627.63
5	应收申购款	309,148.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,018,970.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
28,267	20,451.97	18,359,238.92	3.18%	559,756,563.26	96.82%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	636,237.40	0.11%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年3月17日)基金份额总额	1,509,622,448.13
本报告期期初基金份额总额	599,604,262.21

本报告期基金总申购份额	31,861,792.09
减：本报告期基金总赎回份额	53,350,252.12
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	578,115,802.18

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宁辰先生已离任本公司副总经理职务，敬请投资者关注本公司于2016年4月30日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
长江证券	1	201,697,319.82	7.45%	187,841.09	7.45%	—
方正证券	1	149,480,009.48	5.52%	139,210.94	5.52%	—
国信证券	2	649,938,962.7	24.02%	605,286.1	24.02%	—
申万宏源	1	174,115,191.12	6.43%	162,153.02	6.43%	—
招商证券	1	68,948,363.55	2.55%	64,211.31	2.55%	—
中金公司	2	1,183,466,037.67	43.73%	1,102,163.42	43.73%	—
中信证券	1	278,553,016.73	10.29%	259,415.97	10.29%	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、报告期内新租用证券公司交易单元情况：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
长江证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	123,400,000	4.86%	—	—
申万宏源	—	—	1,461,000,000	57.48%	—	—

招商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信证券	24,611,420.61	100%	957,300,000	37.66%	—	—

天弘基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日